

Zadání diplomové práce

Student: **Bc. Pavlína Ramšová**

Studijní program: N6202 Hospodářská politika a správa

Studijní obor: 6202T010 Finance

Specializace: 00 Finance

Téma: **Kvantifikace rizika portfolia ING Visegrádského akciového fondu
pomocí metody Value at Risk
Quantification of portfolio risk ING Visegrad equity fund by using
Value at Risk method**

Zásady pro vypracování:

1. Úvod
 2. Charakteristika investování do investičních fondů
 3. Popis metody Value at Risk
 4. Kvantifikace hodnoty VaR Višegrádského akciového fondu
 5. Závěr
- Seznam použité literatury
Seznam zkratk
Prohlášení o využití výsledků diplomové práce
Přílohy

Seznam doporučené odborné literatury:

ALEXANDER, C. *Market Risk Analysis: Value-at-Risk Models*. 4th ed. England: John Wiley & Sons, 2008. 449 s. ISBN 978-0-470-99788-8.

HOLTON, G. A. *Value-at-Risk: Theory and Practice*. 1st ed. New York: Academic Press, 2003. 405 s. ISBN 0-12-354010-0.

JORION, P. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk*. 2nd ed. New York: McGraw-Hill, 2001. 544 s. ISBN 0-07-135502-2.

Formální náležitosti a rozsah diplomové práce stanoví pokyny pro vypracování zveřejněné na webových stránkách fakulty.

Vedoucí diplomové práce: **prof. Dr. Ing. Zdeněk Zmeškal**

Datum zadání: 26.11.2010
Datum odevzdání: 29.04.2011

Ing. Iveta Ratmanová, Ph.D.
vedoucí katedry

prof. Dr. Ing. Dana Dluhošová
děkanka fakulty